

汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券 投资基金 2018 年半年度报告

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 25 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	53
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	53
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	53
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	54
§8 基金份额持有人信息.....	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	56
§9 开放式基金份额变动.....	57
§10 重大事件揭示.....	58
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
10.8 其他重大事件.....	63
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	65

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
§12 备查文件目录.....	66
12.1 备查文件目录.....	66
12.2 存放地点.....	66
12.3 查阅方式.....	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金
基金简称	汇添富沪深 300 安中指数
基金主代码	000368
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 11 月 6 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	210,417,228.58 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪沪深 300 安中动态策略指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，以便为投资者带来长期收益。
投资策略	主要采取完全复制法。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	沪深 300 安中动态策略指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金属于股票型指数基金，在证券投资基金中属于较高预期风险、较高预期收益的品种，本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	郭明
	联系电话	021-28932888	010-66105798
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105799
注册地址		上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市富城路 99 号震旦国际大楼 19-22 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号

邮政编码	200120	100140
法定代表人	李文	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金半年度报告备置地点	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 19-22 层 汇添富基金管理股份有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇添富基金管理股份有限公司	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 19-22 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	-4,839,194.61
本期利润	-41,939,416.66
加权平均基金份额本期利润	-0.1871
本期加权平均净值利润率	-11.93%
本期基金份额净值增长率	-11.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	90,347,055.04
期末可供分配基金份额利润	0.4294
期末基金资产净值	300,764,283.62
期末基金份额净值	1.4294
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	42.94%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额；本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

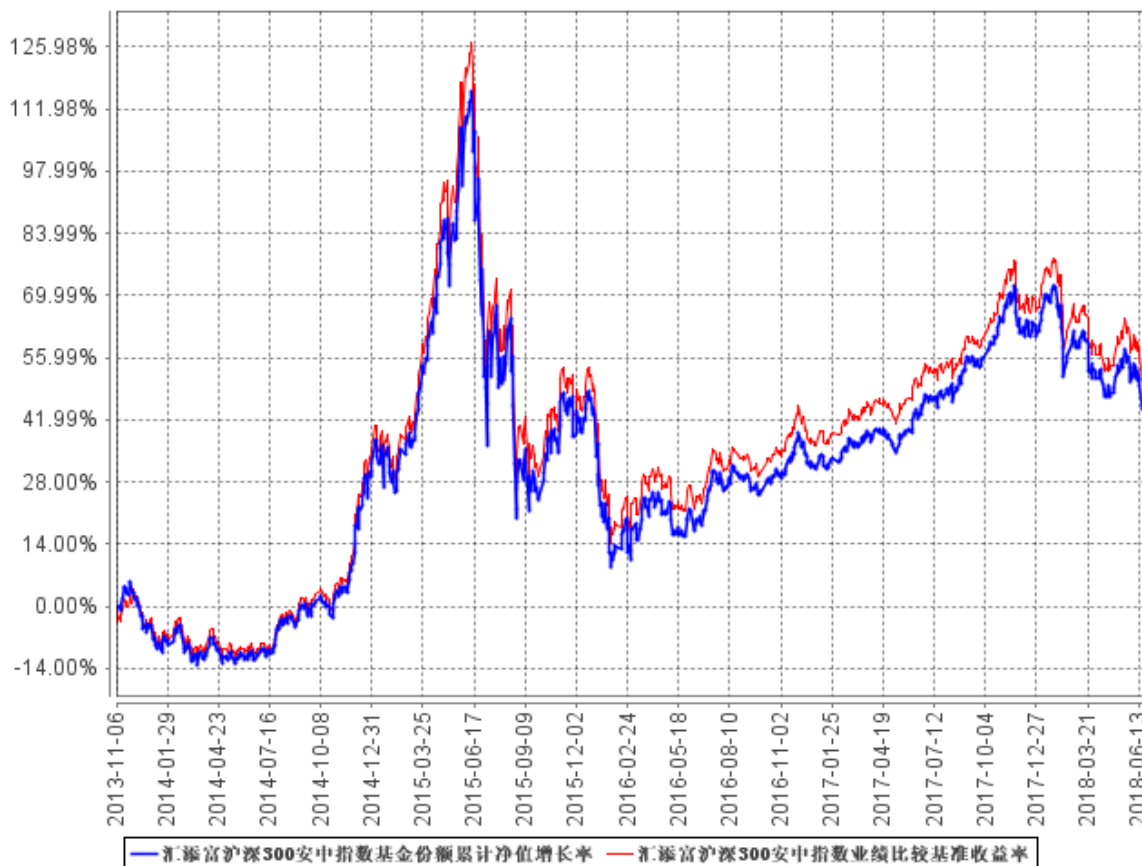
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-6.95%	1.26%	-6.96%	1.20%	0.01%	0.06%
过去三个月	-6.82%	1.08%	-6.25%	1.06%	-0.57%	0.02%
过去六个月	-11.73%	1.13%	-10.87%	1.12%	-0.86%	0.01%
过去一年	-3.02%	0.96%	-3.39%	0.95%	0.37%	0.01%
过去三年	-18.77%	1.57%	-18.49%	1.48%	-0.28%	0.09%
自基金合同生效日起至 今	42.94%	1.55%	48.86%	1.50%	-5.92%	0.05%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

汇添富沪深300安中指数基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2013 年 11 月 6 日）起 6 个月，建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司由东方证券股份有限公司、文汇新民联合报业集团、东航金控有限责任公司共同发起设立，经中国证监会证监基金字（2005）5 号文批准，于 2005 年 2 月 3 日正式成立，注册资本金为 132,724,224 元人民币。截止到 2018 年 6 月 30 日，公司管理证券投资基金规模约 4213.15 亿元，有效客户数约 1988 万户，资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理 110 只开放式证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线，包括汇添富优势精选混合型证券投资基金、汇添富货币市场基金、汇添富均衡增长混合型证券投资基金、汇添富成长焦点混合型证券投资基金、汇添富增强收益债券型证券投资基金、汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金、汇添富价值精选混合型证券投资基金、汇添富上证综合指数证券投资基金、汇添富策略回报混合型证券投资基金、汇添富民营活力混合型证券投资基金、汇添富香港优势混合型证券投资基金、汇添富医药保健混合型证券投资基金、汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富社会责任混合型证券投资基金、汇添富可转换债券债券型证券投资基金、汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）、深证 300 交易型开放式指数证券投资基金、汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富逆向投资混合型证券投资基金、汇添富理财 30 天债券型证券投资基金、汇添富理财 60 天债券型证券投资基金、汇添富理财 14 天债券型证券投资基金、汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金、汇添富多元收益债券型证券投资基金、汇添富收益快线货币市场基金、汇添富优选回报混合型证券投资基金、汇添富消费行业混合型证券投资基金、汇添富理财 7 天债券型证券投资基金、汇添富实业债债券型证券投资基金、汇添富美丽 30 混合型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金、汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、中证能源交易型开放式指数证券投资基金、中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金、汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金、汇添富现金宝货币市场基金、汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金、汇添富纯债债券型证券投资基金（LOF）、汇添富安心中国债券型证券投资基金、汇添富双利增强债券型证券投资基金、汇添富添富通货币市场基金、汇添富全额宝货币市场基金、汇添富恒生指数分级证券投资基金、汇添富和聚宝货币市场基金、汇添富移动互联股票型证券投资基金、汇添富环保行业股票型证券投资基金、汇添富外延增长主题股票型证券投资基金、汇添富收益快线货币市场基金、汇添富成长

多因子量化策略股票基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富医疗服务混合型证券投资基金、汇添富国企创新增长股票型证券投资基金、汇添富民营新动力股票型证券投资基金、汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富新兴消费股票型证券投资基金、汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金、汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金、汇添富稳健添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富盈安保本混合型证券投资基金、汇添富多策略定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金、中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金、汇添富盈稳保本混合型证券投资基金、中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富保鑫保本混合型证券投资基金、汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富新睿精选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富中证生物科技主题指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富鑫瑞债券型证券投资基金、汇添富中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）、汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金、汇添富鑫利债券型证券投资基金、汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、汇添富中国高端制造股票型证券投资基金、汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金、汇添富精选美元债债券型证券投资基金、汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金、汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金、汇添富鑫汇定期开放债券型证券投资基金、汇添富添福吉祥混合型证券投资基金、汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富全球医疗保健混合型证券投资基金、汇添富盈润混合型证券投资基金、汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富民丰回报混合型证券投资基金、汇添富睿丰混合型证券投资基金、汇添富弘安混合型证券投资基金、汇添富港股通专注成长混合型证券投资基金、汇添富中证港股通高股息投资指数发起式证券投资基金（LOF）、上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金、汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富价值创造定期开放混合型证券投资基金、汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富熙和精选混合型证券投资基金、汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金、汇添富行业整合主题混合型证券投资基金、汇添富沪港深大盘价值混合型证券投资基金、汇添富鑫泽定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金、汇添富鑫盛定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富智能制造股票型证券投资基金、汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富文体娱乐主题混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴振翔	汇添富上证综合指数、汇添富沪深 300 安中指数基金、汇添富成长多因子股票基金、汇添富主要消费 ETF 联接基金、汇添富中证精准医指数基金、中证上海国企 ETF、汇添富中证互联网医疗指数（LOF）、汇添富中证 500 指数（LOF）、添富价值多因子股票的基金经理，指数与量化投资部副总监。	2013 年 11 月 6 日	-	12 年	国籍：中国。学历：中国科学技术大学管理学博士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理，现任指数与量化投资部副总监。2010 年 2 月 5 日至今任汇添富上证综合指数基金的基金经理，2011 年 9 月 16 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300ETF 基金的基金经理，2011 年 9 月 28 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300ETF 基金联接基金的基金经理，2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证主要消费 ETF 基金、中证医药卫生 ETF 基金、中证能源 ETF 基金、中证金融地产 ETF 基金的基金经理，2013 年 11 月 6 日至今任汇添富沪深 300 安中指数基金的基金经理，2015 年 2 月 16 日至今任汇添

					富成长多因子股票基金的基金经理，2015 年 3 月 24 日至今任汇添富主要消费 ETF 联接基金的基金经理，2016 年 1 月 21 日至今任汇添富中证精准医指数基金的基金经理，2016 年 7 月 28 日至今任中证上海国企 ETF 的基金经理，2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证互联网医疗指数（LOF）的基金经理，2017 年 8 月 10 日至今任汇添富中证 500 指数（LOF）的基金经理，2018 年 3 月 23 日至今任添富价值多因子股票的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护，根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规，借鉴国际经验，建立了健全、有效的公平交易制度体系，形成涵盖开放

式基金、特定客户资产管理以及社保与养老委托资产的投资管理，涉及交易所市场、银行间市场等各投资市场，债券、股票、回购等各投资标的，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

本报告期内，基金管理人公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化，确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行，包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内，通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查，本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5% 的交易次数为 4 次，由于组合投资策略导致。经检查和分析未发现异常情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2018 年上半年，基本上，经济保持韧性，企业盈利整体向好，贸易维持较高景气度，出口转好。于此同时，金融监管保持定力，流动性结构性偏紧。市场涨跌的主要影响因素包括：上市公司业绩、中美贸易摩擦的反复和大国博弈深化、去杠杆伴随的资金面收紧及信用风险暴露、汇率波动影响海外投资者对人民币资产的风险偏好。

风格上，市值角度，中小市值公司受宏观流动性影响相对较大，财务不确定性高，下跌幅度整体更大；基本面角度，在去杠杆和强监管背景下，财务质地优良、杠杆率合理、盈利能力强、现金流充裕、增长确定性高、基本面与估值匹配度较好的高质量公司具有一定超额收益。

报告期内，本基金遵循指数基金的被动投资原则，保持了指数基金的本质属性。股票投资仓位报告期内基本保持在 90%~95% 之间，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.4294 元；本报告期基金份额净值增长率为-11.73%；同期业绩比较基准收益率为-10.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，中美贸易摩擦以及国内去杠杆的节奏和力度仍是影响市场的主要变量，在此背

景下，内需的韧性和经济结构转型的进度可能成为市场的关注点。当前 A 股整体估值水平处于历史低位，较为充分地反应了市场预期，具备长期投资价值。长期看，贸易争端和去杠杆均是产业升级过程中的必经之路。随着国内经济结构的逐步调整、潜在金融风险的逐步化解、市场透明度的逐步提升，积极因素将逐渐显现，从而改善整体风险偏好，带来新的热点和投资机会。

风格上，A 股有进一步向成熟市场靠拢的可能性，基本面质地优良的股票仍具有核心配置价值。在众多外部变量作用下，风格和行业的切换可能更为频繁。随着市场的逐步企稳，市场关注点很可能从安全性转向长期的成长性上。

作为指数基金，将严格遵守基金合同，继续坚持既定的指数化投资策略，积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差，实现有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》以及 2017 年 9 月 5 日发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（2017 年 9 月 5 日《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》同时废止）等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、固定收益部、集中交易室、基金营运部和稽核监察部人员及基金经理等组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经验，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最

多为 4 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理有限公司编制和披露的汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金 2018 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	20,895,930.56	26,139,279.40
结算备付金		289,115.10	923,067.48
存出保证金		63,546.22	55,052.21
交易性金融资产	6.4.7.2	283,636,726.46	368,537,170.22
其中：股票投资		283,459,713.28	368,348,270.22
基金投资		-	-
债券投资		177,013.18	188,900.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		19,171,727.93	24,088,712.57
应收利息	6.4.7.5	3,839.20	5,499.67
应收股利		-	-
应收申购款		187,563.75	67,579.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		324,248,449.22	419,816,360.89
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		22,356,640.99	30,441,765.69
应付赎回款		272,283.68	242,414.03
应付管理人报酬		128,422.27	165,167.60
应付托管费		25,684.46	33,033.51
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	381,933.02	573,082.77
应交税费		0.67	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	319,200.51	390,879.11
负债合计		23,484,165.60	31,846,342.71
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	210,417,228.58	239,592,806.85
未分配利润	6.4.7.10	90,347,055.04	148,377,211.33
所有者权益合计		300,764,283.62	387,970,018.18
负债和所有者权益总计		324,248,449.22	419,816,360.89

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4294 元，基金份额总额 210,417,228.58 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-39,068,673.33	37,557,539.32
1.利息收入		81,487.23	74,545.13
其中：存款利息收入	6.4.7.11	81,342.97	74,529.88
债券利息收入		144.26	15.25
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,118,519.89	13,552,097.64
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-4,742,340.87	11,562,458.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	25,575.90	715.55
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	2,598,245.08	1,988,923.27
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-37,100,222.05	23,896,595.63
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	68,581.38	34,300.92
减：二、费用		2,870,743.33	2,069,574.44

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	871,242.61	741,511.44
2. 托管费	6.4.10.2.2	174,248.53	148,302.30
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,536,618.43	910,991.20
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.47	-
7. 其他费用	6.4.7.20	288,633.29	268,769.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-41,939,416.66	35,487,964.88

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	239,592,806.85	148,377,211.33	387,970,018.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-41,939,416.66	-41,939,416.66
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-29,175,578.27	-16,090,739.63	-45,266,317.90
其中：1. 基金申购款	20,448,855.82	11,682,020.17	32,130,875.99
2. 基金赎回款	-49,624,434.09	-27,772,759.80	-77,397,193.89
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	210,417,228.58	90,347,055.04	300,764,283.62
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	209,201,323.44	65,223,635.17	274,424,958.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	35,487,964.88	35,487,964.88
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	19,353,817.02	7,599,513.11	26,953,330.13
其中：1.基金申购款	42,582,786.86	16,300,230.60	58,883,017.46
2.基金赎回款	-23,228,969.84	-8,700,717.49	-31,929,687.33
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	228,555,140.46	108,311,113.16	336,866,253.62

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>张晖</u>	<u>李骁</u>	<u>雷青松</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2013]1209 号文《关于核准汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人汇添富基金管理股份有限公司向社会公开发行人募集，基金合同于 2013 年 11 月 06 日正式生效，首次设立募集规模为 274,994,745.19 基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以沪深 300 安中动态策略指数的成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基

金进行被动式指数化投资，紧密跟踪沪深 300 安中动态策略指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，以便为投资者带来长期收益。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 安中动态策略指数收益率 $\times 95\%$ + 金融机构人民币活期存款基准利率（税后） $\times 5\%$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年上半年的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	20,895,930.56
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	20,895,930.56

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	302,219,255.20	283,459,713.28	-18,759,541.92
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	165,600.00	177,013.18
	银行间市场	-	-
	合计	165,600.00	177,013.18
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	302,384,855.20	283,636,726.46	-18,748,128.74

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日

应收活期存款利息	3,591.00
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	117.09
应收债券利息	105.37
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	25.74
合计	3,839.20

注：“其他”为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	381,933.02
银行间市场应付交易费用	-
合计	381,933.02

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	763.22
应付信息披露费	228,765.71
应付审计费	39,671.58
应付指数使用费	50,000.00
合计	319,200.51

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	239,592,806.85	239,592,806.85
本期申购	20,448,855.82	20,448,855.82
本期赎回(以“-”号填列)	-49,624,434.09	-49,624,434.09
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	210,417,228.58	210,417,228.58

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	115,993,330.63	32,383,880.70	148,377,211.33
本期利润	-4,839,194.61	-37,100,222.05	-41,939,416.66
本期基金份额交易产生的变动数	-14,191,772.49	-1,898,967.14	-16,090,739.63
其中：基金申购款	10,005,010.57	1,677,009.60	11,682,020.17
基金赎回款	-24,196,783.06	-3,575,976.74	-27,772,759.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	96,962,363.53	-6,615,308.49	90,347,055.04

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	72,350.47
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	8,024.35
其他	968.15
合计	81,342.97

注：“其他”为结算保证金利息收入和申购款利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	522,503,488.20
减：卖出股票成本总额	527,245,829.07
买卖股票差价收入	-4,742,340.87

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	25,575.90
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	25,575.90

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	212,234.80
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	186,600.00
减：应收利息总额	58.90
买卖债券差价收入	25,575.90

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,598,245.08
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,598,245.08

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-37,100,222.05
——股票投资	-37,111,635.23
——债券投资	11,413.18
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-37,100,222.05

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	68,581.38
合计	68,581.38

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,536,618.43
银行间市场交易费用	-
合计	1,536,618.43

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	148,765.71
账户维护费	-
银行费用	196.00
指数使用费	100,000.00
合计	288,633.29

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银	基金托管人、基金代销机构

行”)	
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	871,242.61	741,511.44
其中：支付销售机构的客户维护费	49,041.11	36,029.10

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假

等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	174,248.53	148,302.30

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，于次月前 5 个工作日内按照指定的账户路径从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比区间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末和上年度末未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	20,895,930.56	72,350.47	22,500,738.46	68,214.19

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603693	江苏新能	2018 年 6 月 25 日	2018 年 7 月 3 日	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018 年 6 月 29 日	2018 年 7 月 9 日	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600485	信威集团	2016 年 12 月 26 日	重大资产重组停牌	14.59	-	-	173,842	3,443,861.58	2,536,354.78	-
002252	上海莱士	2018 年 2 月 23 日	重大资产重组	21.46	-	-	60,770	1,216,480.68	1,304,124.20	-

			停牌							
002450	康得新	2018年6月4日	重大资产重组停牌	17.08	-	-	61,375	1,194,740.42	1,048,285.00	-
002739	万达电影	2017年7月4日	重大资产重组停牌	38.03	-	-	27,400	1,495,954.91	1,042,022.00	-
002411	必康股份	2018年6月19日	重大事项停牌	28.34	-	-	25,300	667,581.87	717,002.00	-
601390	中国中铁	2018年5月7日	重大资产重组停牌	7.47	2018年8月20日	7.25	79,070	685,311.50	590,652.90	-
600221	海航控股	2018年1月10日	重大资产重组停牌	3.23	2018年7月20日	2.91	180,417	592,499.12	582,746.91	-
000723	美锦能源	2018年3月27日	重大资产	5.43	2018年7月31日	4.89	103,900	690,360.03	564,177.00	-

			重组停牌							
300072	三聚环保	2018年6月19日	重大事项停牌	23.28	2018年7月10日	24.00	23,900	781,991.19	556,392.00	-
601727	上海电气	2018年6月6日	重大资产重组停牌	6.34	2018年8月7日	5.71	51,291	516,507.53	325,184.94	-
002310	东方园林	2018年5月25日	重大资产重组停牌	15.03		-	18,900	314,791.83	284,067.00	-
601118	海南橡胶	2018年5月24日	重大资产重组停牌	6.62		-	34,506	208,754.07	228,429.72	-
002602	世纪华通	2018年6月12日	重大资产重组停牌	32.50		-	7,000	230,405.00	227,500.00	-
000415	渤海	2018年1	重大	5.84	2018年7	5.26	28,600	204,536.25	167,024.00	-

	金控	月 17 日	资产重组停牌		月 17 日						
000540	中天金融	2017 年 8 月 21 日	重大资产重组停牌	4.87	-	-	31,650	143,868.61	154,135.50	-	
000008	神州高铁	2018 年 6 月 6 日	重大事项停牌	4.96		2018 年 8 月 7 日	4.46	25,500	206,796.55	126,480.00	-
002426	胜利精密	2018 年 6 月 19 日	重大事项停牌	3.60		2018 年 7 月 3 日	3.26	32,700	245,905.53	117,720.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风

险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行，另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持证券均在证券交易所上市；因此，除本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及部分应收申购款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	20,895,930.56	-	-	-	-	-	20,895,930.56
结算备付金	289,115.10	-	-	-	-	-	289,115.10
存出保证金	63,546.22	-	-	-	-	-	63,546.22
交易性金融资产	-	-	159,160.32	17,852.86	-	283,459,713.28	283,636,726.46
应收证券清算款	-	-	-	-	-	19,171,727.93	19,171,727.93
应收利息	-	-	-	-	-	3,839.20	3,839.20
应收申购款	119,679.16	-	-	-	-	67,884.59	187,563.75
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	21,368,271.04	-	159,160.32	17,852.86	-	302,703,165.00	324,248,449.22
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	22,356,640.99	22,356,640.99
应付赎回款	-	-	-	-	-	272,283.68	272,283.68
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	128,422.27	128,422.27
应付托管费	-	-	-	-	-	25,684.46	25,684.46
应付交易费用	-	-	-	-	-	381,933.02	381,933.02
应交税费	-	-	-	-	-	0.67	0.67
其他负债	-	-	-	-	-	319,200.51	319,200.51
负债总计	-	-	-	-	-	23,484,165.60	23,484,165.60
利率敏感度缺口	21,368,271.04	-	159,160.32	17,852.86	-	279,218,999.40	300,764,283.62
上年度末 2017年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	26,139,279.40	-	-	-	-	-	26,139,279.40
结算备付金	923,067.48	-	-	-	-	-	923,067.48
存出保证金	55,052.21	-	-	-	-	-	55,052.21

交易性金融资产	-	-188,900.00	-	-	368,348,270.22	368,537,170.22
应收证券清算款	-	-	-	-	24,088,712.57	24,088,712.57
应收利息	-	-	-	-	5,499.67	5,499.67
应收申购款	30,687.76	-	-	-	36,891.58	67,579.34
资产总计	27,148,086.85	-188,900.00	-	-	392,479,374.04	419,816,360.89
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	30,441,765.69	30,441,765.69
应付赎回款	-	-	-	-	242,414.03	242,414.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	165,167.60	165,167.60
应付托管费	-	-	-	-	33,033.51	33,033.51
应付交易费用	-	-	-	-	573,082.77	573,082.77
其他负债	-	-	-	-	390,879.11	390,879.11
负债总计	-	-	-	-	31,846,342.71	31,846,342.71
利率敏感度缺口	27,148,086.85	-188,900.00	-	-	-360,633,031.33	387,970,018.18

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期末及上年度末计息资产仅包括银行存款、结算备付金、存出保证金及部分应收申购款，且均以活期存款利率或相对固定的利率计息；假定利率变动仅影响其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本报告期末及上年度末未持有其他计息资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
----	-------------------	---------------------

	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	283,459,713.28	94.25	368,348,270.22	94.94
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	177,013.18	0.06	188,900.00	0.05
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	283,636,726.46	94.31	368,537,170.22	94.99

注：本基金投资于沪深 300 安中动态策略指数的成份股的组合比例不低于基金资产的 90%，持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018年6月30日）	上年度末（2017年12月31日）
	沪深 300 安中动态指数上涨 5%	14,449,088.86	19,524,864.91
	沪深 300 安中动态指数下跌 5%	-14,449,088.86	-19,524,864.91

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	283,459,713.28	87.42
	其中：股票	283,459,713.28	87.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	177,013.18	0.05
	其中：债券	177,013.18	0.05
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	21,185,045.66	6.53
8	其他各项资产	19,426,677.10	5.99
9	合计	324,248,449.22	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,711,710.00	0.57
B	采矿业	21,005,994.53	6.98
C	制造业	172,299,363.04	57.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,861,921.39	6.60
E	建筑业	5,734,608.90	1.91
F	批发和零售业	8,457,359.06	2.81
G	交通运输、仓储和邮政业	4,680,767.21	1.56
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,588,684.57	4.85
J	金融业	16,424,619.05	5.46
K	房地产业	3,422,163.93	1.14
L	租赁和商务服务业	6,961,495.62	2.31
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	555,178.90	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,530,738.63	0.51
R	文化、体育和娱乐业	2,474,878.27	0.82
S	综合	-	-
	合计	279,709,483.10	93.00

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	228,429.72	0.08
B	采掘业	-	-
C	制造业	3,167,910.07	1.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	201,104.40	0.07
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,750,230.18	1.25

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	16,983	12,422,385.18	4.13
2	600887	伊利股份	418,432	11,674,252.80	3.88
3	000333	美的集团	221,307	11,556,651.54	3.84
4	000651	格力电器	229,715	10,831,062.25	3.60
5	000858	五粮液	130,969	9,953,644.00	3.31
6	600900	长江电力	462,962	7,472,206.68	2.48
7	002304	洋河股份	44,278	5,826,984.80	1.94
8	600104	上汽集团	158,282	5,538,287.18	1.84
9	600050	中国联通	1,029,268	5,063,998.56	1.68
10	600028	中国石化	756,351	4,908,717.99	1.63
11	603288	海天味业	60,300	4,440,492.00	1.48
12	600276	恒瑞医药	57,401	4,348,699.76	1.45
13	000063	中兴通讯	299,928	3,908,061.84	1.30
14	002027	分众传媒	372,912	3,568,767.84	1.19
15	000568	泸州老窖	57,858	3,521,237.88	1.17
16	601857	中国石油	455,070	3,508,589.70	1.17
17	600690	青岛海尔	177,628	3,421,115.28	1.14
18	002415	海康威视	88,693	3,293,171.09	1.09
19	601318	中国平安	54,088	3,168,475.04	1.05
20	600487	DR 亨通光	141,600	3,122,280.00	1.04
21	601888	中国国旅	46,738	3,010,394.58	1.00
22	601088	中国神华	149,411	2,979,255.34	0.99
23	300136	信维通信	85,200	2,618,196.00	0.87
24	002024	苏宁易购	178,359	2,511,294.72	0.83
25	601225	陕西煤业	304,166	2,500,244.52	0.83
26	601933	永辉超市	326,792	2,496,690.88	0.83
27	000895	双汇发展	91,242	2,409,701.22	0.80
28	600522	中天科技	264,100	2,326,721.00	0.77
29	601668	中国建筑	401,174	2,190,410.04	0.73
30	600795	国电电力	819,548	2,147,215.76	0.71
31	600886	国投电力	286,339	2,081,684.53	0.69
32	000725	京东方 A	575,638	2,037,758.52	0.68
33	002594	比亚迪	40,847	1,947,584.96	0.65

34	600309	万华化学	41,975	1,906,504.50	0.63
35	600804	鹏博士	157,349	1,888,188.00	0.63
36	601985	中国核电	329,600	1,862,240.00	0.62
37	600019	宝钢股份	236,174	1,839,795.46	0.61
38	600011	华能国际	280,500	1,783,980.00	0.59
39	600518	康美药业	76,299	1,745,721.12	0.58
40	600809	山西汾酒	27,600	1,735,764.00	0.58
41	600585	海螺水泥	51,825	1,735,101.00	0.58
42	002714	牧原股份	38,500	1,711,710.00	0.57
43	600741	华域汽车	72,000	1,707,840.00	0.57
44	600660	福耀玻璃	64,715	1,663,822.65	0.55
45	000876	新希望	245,936	1,559,234.24	0.52
46	600438	通威股份	220,200	1,519,380.00	0.51
47	600498	烽火通信	60,100	1,493,485.00	0.50
48	000538	云南白药	13,335	1,426,311.60	0.47
49	000100	TCL 集团	485,365	1,407,558.50	0.47
50	600036	招商银行	53,089	1,403,673.16	0.47
51	600674	川投能源	157,991	1,377,681.52	0.46
52	002385	大北农	318,970	1,317,346.10	0.44
53	600023	浙能电力	281,011	1,309,511.26	0.44
54	002252	上海莱士	60,770	1,304,124.20	0.43
55	600066	宇通客车	61,430	1,178,841.70	0.39
56	300059	东方财富	87,024	1,146,976.32	0.38
57	600196	复星医药	27,093	1,121,379.27	0.37
58	600703	三安光电	58,326	1,121,025.72	0.37
59	002230	科大讯飞	34,682	1,112,251.74	0.37
60	002450	康得新	61,375	1,048,285.00	0.35
61	002008	大族激光	19,672	1,046,353.68	0.35
62	002739	万达电影	27,400	1,042,022.00	0.35
63	002572	索菲亚	31,800	1,023,324.00	0.34
64	600398	海澜之家	79,200	1,009,008.00	0.34
65	300003	乐普医疗	27,200	997,696.00	0.33
66	601988	中国银行	272,834	984,930.74	0.33
67	600867	通化东宝	39,000	934,830.00	0.31
68	600188	兖州煤业	70,738	922,423.52	0.31
69	601166	兴业银行	63,763	918,187.20	0.31
70	002236	大华股份	40,707	917,942.85	0.31
71	601899	紫金矿业	253,975	916,849.75	0.30
72	000963	华东医药	18,586	896,774.50	0.30

73	600436	片仔癀	8,000	895,440.00	0.30
74	600177	雅戈尔	115,420	888,734.00	0.30
75	000983	西山煤电	117,637	883,453.87	0.29
76	600637	东方明珠	57,879	871,657.74	0.29
77	600016	民生银行	121,813	852,691.00	0.28
78	600157	永泰能源	468,515	833,956.70	0.28
79	002475	立讯精密	36,042	812,386.68	0.27
80	600583	海油工程	154,337	811,812.62	0.27
81	601766	中国中车	105,156	809,701.20	0.27
82	300144	宋城演艺	34,400	808,400.00	0.27
83	000625	长安汽车	89,638	806,742.00	0.27
84	601328	交通银行	140,493	806,429.82	0.27
85	603799	华友钴业	8,200	799,254.00	0.27
86	300015	爱尔眼科	24,547	792,622.63	0.26
87	002466	天齐锂业	15,935	790,216.65	0.26
88	600009	上海机场	13,566	752,641.68	0.25
89	601607	上海医药	31,059	742,310.10	0.25
90	002044	美年健康	32,660	738,116.00	0.25
91	600352	浙江龙盛	61,585	735,940.75	0.24
92	002508	老板电器	23,500	719,570.00	0.24
93	002411	必康股份	25,300	717,002.00	0.24
94	002456	欧菲科技	44,287	714,349.31	0.24
95	601006	大秦铁路	86,293	708,465.53	0.24
96	002460	赣锋锂业	18,050	696,369.00	0.23
97	600008	首创股份	164,562	694,451.64	0.23
98	601288	农业银行	195,393	672,151.92	0.22
99	600030	中信证券	40,004	662,866.28	0.22
100	600297	广汇汽车	112,490	659,191.40	0.22
101	600271	航天信息	25,963	656,085.01	0.22
102	601898	中煤能源	135,500	654,465.00	0.22
103	000423	东阿阿胶	11,958	643,459.98	0.21
104	000002	万科 A	25,823	635,245.80	0.21
105	600516	方大炭素	25,800	629,004.00	0.21
106	600570	恒生电子	11,839	626,875.05	0.21
107	600535	天士力	23,781	614,025.42	0.20
108	300408	三环集团	25,800	606,300.00	0.20
109	600688	上海石化	105,741	601,666.29	0.20
110	000338	潍柴动力	68,760	601,650.00	0.20
111	601600	中国铝业	155,638	597,649.92	0.20

112	601390	中国中铁	79,070	590,652.90	0.20
113	300122	智飞生物	12,900	590,046.00	0.20
114	600111	北方稀土	51,608	587,299.04	0.20
115	600031	三一重工	65,385	586,503.45	0.20
116	600221	海航控股	180,417	582,746.91	0.19
117	601186	中国铁建	66,866	576,384.92	0.19
118	600000	浦发银行	60,245	575,942.20	0.19
119	000503	国新健康	18,039	573,279.42	0.19
120	600332	白云山	14,851	565,080.55	0.19
121	000723	美锦能源	103,900	564,177.00	0.19
122	000413	东旭光电	93,076	564,040.56	0.19
123	600682	南京新百	34,300	563,892.00	0.19
124	300072	三聚环保	23,900	556,392.00	0.18
125	002085	万丰奥威	58,800	552,720.00	0.18
126	603833	欧派家居	4,300	548,379.00	0.18
127	600176	中国巨石	53,400	546,282.00	0.18
128	600588	用友网络	21,555	528,313.05	0.18
129	601989	中国重工	130,200	526,008.00	0.17
130	600010	宝钢股份	338,988	525,431.40	0.17
131	601991	大唐发电	171,200	518,736.00	0.17
132	600085	同仁堂	14,644	516,640.32	0.17
133	601601	中国太保	16,055	511,351.75	0.17
134	600339	中油工程	108,000	484,920.00	0.16
135	002241	歌尔股份	46,798	476,871.62	0.16
136	300124	汇川技术	14,269	468,308.58	0.16
137	002007	华兰生物	14,324	460,659.84	0.15
138	601012	隆基股份	27,580	460,310.20	0.15
139	600048	保利地产	37,192	453,742.40	0.15
140	601169	北京银行	74,550	449,536.50	0.15
141	000786	北新建材	23,100	428,043.00	0.14
142	600547	山东黄金	17,745	424,460.40	0.14
143	600406	国电南瑞	26,670	421,386.00	0.14
144	002294	信立泰	11,200	416,304.00	0.14
145	600029	南方航空	49,130	415,148.50	0.14
146	002493	荣盛石化	39,900	411,768.00	0.14
147	000001	平安银行	44,860	407,777.40	0.14
148	000623	吉林敖东	22,436	403,399.28	0.13
149	600362	江西铜业	25,301	401,020.85	0.13
150	601808	中海油服	41,700	397,818.00	0.13

151	600837	海通证券	40,595	384,434.65	0.13
152	600025	华能水电	125,100	380,304.00	0.13
153	002202	金风科技	29,959	378,681.76	0.13
154	300070	碧水源	26,930	375,134.90	0.12
155	600089	特变电工	53,257	369,071.01	0.12
156	600100	同方股份	41,787	366,889.86	0.12
157	600115	东方航空	55,111	364,834.82	0.12
158	600219	南山铝业	134,300	363,953.00	0.12
159	000792	盐湖股份	33,354	360,890.28	0.12
160	300017	网宿科技	33,559	359,416.89	0.12
161	601669	中国电建	66,443	356,134.48	0.12
162	603993	洛阳钼业	55,576	349,573.04	0.12
163	601238	广汽集团	30,600	340,884.00	0.11
164	002558	巨人网络	14,300	340,054.00	0.11
165	000630	铜陵有色	151,410	334,616.10	0.11
166	002065	东华软件	38,348	329,792.80	0.11
167	601727	上海电气	51,291	325,184.94	0.11
168	000709	河钢股份	105,845	312,242.75	0.10
169	000768	中航飞机	19,133	299,240.12	0.10
170	601818	光大银行	81,610	298,692.60	0.10
171	600068	葛洲坝	40,550	292,365.50	0.10
172	000060	中金岭南	59,334	288,363.24	0.10
173	002310	东方园林	18,900	284,067.00	0.09
174	600489	中金黄金	41,433	282,573.06	0.09
175	603858	步长制药	6,600	282,414.00	0.09
176	002624	完美世界	9,100	282,191.00	0.09
177	600893	航发动力	12,607	281,388.24	0.09
178	601211	国泰君安	19,000	280,060.00	0.09
179	300024	机器人	15,658	272,449.20	0.09
180	002470	金正大	39,228	269,888.64	0.09
181	000898	鞍钢股份	48,100	267,917.00	0.09
182	601216	君正集团	79,334	267,355.58	0.09
183	600739	辽宁成大	17,584	266,925.12	0.09
184	601919	中远海控	54,114	266,240.88	0.09
185	000157	中联重科	63,915	262,690.65	0.09
186	000425	徐工机械	61,783	261,959.92	0.09
187	601618	中国中冶	78,321	260,808.93	0.09
188	601992	金隅集团	79,400	260,432.00	0.09
189	600346	恒力股份	17,700	259,482.00	0.09

190	600018	上港集团	43,028	256,446.88	0.09
191	601800	中国交建	22,175	252,573.25	0.08
192	601111	中国国航	27,965	248,608.85	0.08
193	601688	华泰证券	16,558	247,873.26	0.08
194	600015	华夏银行	32,710	243,689.50	0.08
195	600549	厦门钨业	15,730	238,781.40	0.08
196	001979	招商蛇口	12,448	237,134.40	0.08
197	601018	宁波港	56,089	236,134.69	0.08
198	002608	江苏国信	33,900	233,910.00	0.08
199	002625	光启技术	19,800	231,858.00	0.08
200	002081	金螳螂	22,882	231,108.20	0.08
201	601939	建设银行	34,774	227,769.70	0.08
202	002602	世纪华通	7,000	227,500.00	0.08
203	002153	石基信息	7,836	227,244.00	0.08
204	600919	江苏银行	35,200	225,632.00	0.08
205	000938	紫光股份	3,600	225,360.00	0.07
206	600482	中国动力	12,300	214,635.00	0.07
207	002142	宁波银行	13,123	213,773.67	0.07
208	000839	中信国安	44,800	211,904.00	0.07
209	601333	广深铁路	49,261	209,359.25	0.07
210	601009	南京银行	26,336	203,577.28	0.07
211	600170	上海建工	64,842	197,119.68	0.07
212	000776	广发证券	14,728	195,440.56	0.06
213	600977	中国电影	12,000	192,480.00	0.06
214	601360	三六零	6,600	190,740.00	0.06
215	300033	同花顺	4,900	190,463.00	0.06
216	601628	中国人寿	8,451	190,316.52	0.06
217	601117	中国化学	28,100	189,113.00	0.06
218	601633	长城汽车	19,239	188,926.98	0.06
219	600153	建发股份	20,966	188,484.34	0.06
220	300433	蓝思科技	8,600	180,428.00	0.06
221	000826	启迪桑德	10,300	180,044.00	0.06
222	002601	龙鳞佰利	13,900	179,727.00	0.06
223	601336	新华保险	4,124	176,837.12	0.06
224	300027	华谊兄弟	27,695	170,601.20	0.06
225	000959	首钢股份	41,400	170,154.00	0.06
226	600415	小商品城	39,320	169,469.20	0.06
227	000415	渤海金控	28,600	167,024.00	0.06
228	600820	隧道股份	27,700	163,707.00	0.05

229	600340	华夏幸福	6,261	161,220.75	0.05
230	600118	中国卫星	8,440	161,204.00	0.05
231	600999	招商证券	11,456	156,718.08	0.05
232	002925	盈趣科技	2,800	155,064.00	0.05
233	002050	三花智控	8,200	154,570.00	0.05
234	000540	中天金融	31,650	154,135.50	0.05
235	000559	万向钱潮	22,601	153,686.80	0.05
236	601155	新城控股	4,900	151,753.00	0.05
237	300251	光线传媒	14,614	148,770.52	0.05
238	601958	金钼股份	23,426	146,881.02	0.05
239	002352	顺丰控股	3,200	144,000.00	0.05
240	002074	国轩高科	9,850	138,491.00	0.05
241	601901	方正证券	20,700	138,483.00	0.05
242	601877	正泰电器	6,200	138,384.00	0.05
243	601021	春秋航空	3,910	136,967.30	0.05
244	600704	物产中大	25,200	131,796.00	0.04
245	600038	中直股份	3,278	131,087.22	0.04
246	000069	华侨城 A	17,987	130,046.01	0.04
247	600959	江苏有线	25,330	129,183.00	0.04
248	600606	绿地控股	18,900	123,606.00	0.04
249	601377	兴业证券	23,226	122,401.02	0.04
250	600383	金地集团	11,630	118,509.70	0.04
251	601866	中远海发	46,408	115,555.92	0.04
252	600373	中文传媒	8,763	112,604.55	0.04
253	002736	国信证券	12,320	112,112.00	0.04
254	601788	光大证券	9,708	106,593.84	0.04
255	600705	中航资本	22,238	103,851.46	0.03
256	000783	长江证券	19,042	103,398.06	0.03
257	000166	申万宏源	23,530	102,826.10	0.03
258	600372	中航电子	7,676	100,248.56	0.03
259	601998	中信银行	15,409	95,689.89	0.03
260	002555	三七互娱	7,800	94,770.00	0.03
261	601611	中国核建	11,500	90,850.00	0.03
262	601718	际华集团	22,000	88,440.00	0.03
263	601997	贵阳银行	7,100	87,756.00	0.03
264	603260	合盛硅业	1,200	84,684.00	0.03
265	600208	新湖中宝	21,933	83,784.06	0.03
266	002146	荣盛发展	9,196	80,281.08	0.03
267	601555	东吴证券	11,685	79,808.55	0.03

268	601099	太平洋	34,005	79,571.70	0.03
269	600816	安信信托	10,964	79,379.36	0.03
270	601212	白银有色	18,900	77,301.00	0.03
271	002468	申通快递	4,300	73,745.00	0.02
272	600109	国金证券	10,302	73,247.22	0.02
273	000728	国元证券	9,888	73,171.20	0.02
274	603160	汇顶科技	1,100	71,379.00	0.02
275	601198	东兴证券	5,400	70,416.00	0.02
276	002797	第一创业	10,240	69,324.80	0.02
277	601229	上海银行	4,240	66,822.40	0.02
278	600233	圆通速递	4,900	64,680.00	0.02
279	601228	广州港	11,100	64,491.00	0.02
280	002673	西部证券	8,380	63,269.00	0.02
281	000961	中南建设	9,400	59,314.00	0.02
282	600663	陆家嘴	3,607	56,954.53	0.02
283	002500	山西证券	8,330	56,144.20	0.02
284	600369	西南证券	13,858	53,353.30	0.02
285	000671	阳光城	8,600	51,342.00	0.02
286	000627	天茂集团	7,300	51,246.00	0.02
287	000402	金融街	6,034	48,573.70	0.02
288	600376	首开股份	6,700	47,101.00	0.02
289	601828	美凯龙	3,000	45,840.00	0.02
290	001965	招商公路	5,000	40,700.00	0.01
291	600061	国投资本	4,200	38,976.00	0.01
292	600909	华安证券	5,700	32,604.00	0.01
293	601881	中国银河	3,300	26,829.00	0.01
294	600926	杭州银行	2,000	22,180.00	0.01
295	601108	财通证券	1,400	15,792.00	0.01
296	601878	浙商证券	1,800	15,120.00	0.01
297	600390	五矿资本	1,700	13,175.00	0.00
298	601838	成都银行	1,400	12,250.00	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600485	信威集团	173,842	2,536,354.78	0.84
2	601118	海南橡胶	34,506	228,429.72	0.08

3	601066	中信建投	18,690	201,104.40	0.07
4	000008	神州高铁	25,500	126,480.00	0.04
5	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.04
6	002426	胜利精密	32,700	117,720.00	0.04
7	300745	欣锐科技	1,304	107,032.32	0.04
8	603486	科沃斯	1,639	105,338.53	0.04
9	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.03
10	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.02
11	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.02
12	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600887	伊利股份	19,988,941.56	5.15
2	000858	五粮液	15,590,897.47	4.02
3	600900	长江电力	15,520,293.55	4.00
4	600795	国电电力	12,276,041.00	3.16
5	600519	贵州茅台	11,751,240.00	3.03
6	601985	中国核电	11,302,267.63	2.91
7	600050	中国联通	10,847,821.99	2.80
8	600886	国投电力	10,739,255.25	2.77
9	600028	中国石化	10,424,801.00	2.69
10	600276	恒瑞医药	10,189,559.00	2.63
11	300136	信维通信	9,636,663.07	2.48
12	600011	华能国际	9,523,367.43	2.45
13	601318	中国平安	9,275,341.21	2.39
14	002304	洋河股份	9,221,400.00	2.38
15	601088	中国神华	8,931,912.00	2.30
16	601857	中国石油	8,852,174.59	2.28
17	600522	中天科技	8,298,782.36	2.14
18	000333	美的集团	7,737,971.50	1.99
19	600023	浙能电力	7,724,636.00	1.99
20	002465	海格通信	7,409,588.68	1.91

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600887	伊利股份	25,363,669.05	6.54
2	600276	恒瑞医药	24,993,705.91	6.44
3	600519	贵州茅台	19,096,666.42	4.92
4	000858	五粮液	19,088,451.69	4.92
5	600900	长江电力	16,430,157.43	4.23
6	600795	国电电力	11,907,874.00	3.07
7	601985	中国核电	11,057,038.24	2.85
8	002304	洋河股份	10,901,987.59	2.81
9	600518	康美药业	10,804,296.19	2.78
10	600028	中国石化	10,665,529.04	2.75
11	600886	国投电力	10,493,999.40	2.70
12	300136	信维通信	10,244,950.71	2.64
13	601318	中国平安	9,117,261.24	2.35
14	000538	云南白药	9,114,048.66	2.35
15	600011	华能国际	8,995,061.94	2.32
16	600050	中国联通	8,994,814.36	2.32
17	601857	中国石油	8,911,708.00	2.30
18	601088	中国神华	8,713,652.00	2.25
19	600522	中天科技	7,900,251.59	2.04
20	002465	海格通信	7,537,704.52	1.94

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	480,992,075.65
卖出股票收入（成交）总额	522,503,488.20

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	177,013.18	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	177,013.18	0.06

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123006	东财转债	699	84,065.93	0.03
2	127006	敖东转债	769	75,094.39	0.02
3	127005	长证转债	188	17,852.86	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	63,546.22
2	应收证券清算款	19,171,727.93
3	应收股利	-
4	应收利息	3,839.20
5	应收申购款	187,563.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,426,677.10

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123006	东财转债	84,065.93	0.03

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600485	信威集团	2,536,354.78	0.84	重大资产重组停牌
2	601118	海南橡胶	228,429.72	0.08	重大资产重组停牌
3	000008	神州高铁	126,480.00	0.04	重大事项停牌

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
4,331	48,583.98	154,086,711.95	73.23%	56,330,516.63	26.77%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	26,816.67	0.0127%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部 门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 11 月 6 日）基金份额总额	274,994,745.19
本报告期期初基金份额总额	239,592,806.85
本报告期基金总申购份额	20,448,855.82
减:本报告期基金总赎回份额	49,624,434.09
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	210,417,228.58

注：其中“总申购份额”含红利再投、转换入份额；“总赎回份额”含转换出份额

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 《汇添富价值创造定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 1 月 19 日正式生效，胡昕炜先生任该基金的基金经理。
2. 《汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 1 月 25 日正式生效，吴江宏先生任该基金的基金经理。
3. 《汇添富熙和精选混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 11 日正式生效，曾刚先生任该基金的基金经理。
4. 《汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 13 日正式生效，陈加荣先生任该基金的基金经理。
5. 《汇添富行业整合主题混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 13 日正式生效，赵鹏程先生任该基金的基金经理。
6. 《汇添富沪港深大盘价值混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 13 日正式生效，陈健玮先生和劳杰男先生任该基金的基金经理。
7. 基金管理人于 2018 年 2 月 14 日公告，增聘胡娜女士担任汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金的基金经理，与陈加荣先生共同管理该基金。
8. 基金管理人 2018 年 3 月 2 日公告，劳杰男先生不再担任汇添富国企创新增长股票型证券投资基金的基金经理，由李威先生单独管理该基金。
9. 基金管理人于 2018 年 3 月 2 日公告，增聘郑慧莲女士担任汇添富熙和精选混合型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金。
10. 《汇添富鑫泽定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 3 月 8 日正式生效，李怀定先生和陆文磊先生任该基金的基金经理。
11. 基金管理人于 2018 年 3 月 20 日公告，增聘赵鹏飞先生担任汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金的基金经理，与陈加荣先生、胡娜女士共同管理该基金。
12. 《汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金基金合同》于 2018 年 3 月 23 日正式生效，吴振翔先生和许一尊先生任该基金的基金经理。
13. 基金管理人于 2018 年 4 月 3 日公告，增聘郑慧莲女士担任汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金。
14. 《汇添富鑫盛定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 16 日正式生效，吴江宏先生和胡娜女士任该基金的基金经理。
15. 《汇添富智能制造股票型证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 23 日正式生效，赵鹏飞先生任该基金的基金经理。
16. 《汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 26 日正式生效，陈加荣先生任该基金的基金经理。
17. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，蒋文玲女士不再担任汇添富理财 14 天债券型证券投资基金的基金经理，增聘徐寅喆女士担任该基金的基金经理，由徐寅喆女士单独管理该基金。
18. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，蒋文玲女士不再担任汇添富理财 30 天债券型证券

投资基金的基金经理，增聘徐寅喆女士担任该基金的基金经理，由徐寅喆女士单独管理该基金。

19. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，蒋文玲女士不再担任汇添富理财 60 天债券型证券投资基金的基金经理，增聘徐寅喆女士担任该基金的基金经理，由徐寅喆女士单独管理该基金。

20. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，徐寅喆女士不再担任汇添富全额宝货币市场基金的基金经理，增聘陶然先生担任该基金的基金经理，由陶然先生单独管理该基金。

21. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，陆文磊先生和徐寅喆女士不再担任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理，增聘陶然先生担任该基金的基金经理，由陶然先生单独管理该基金。

22. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，徐寅喆女士不再担任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理，增聘陶然先生担任该基金的基金经理，由陶然先生单独管理该基金。

23. 基金管理人于 2018 年 5 月 5 日公告，增聘徐寅喆女士担任汇添富货币市场基金的基金经理，与蒋文玲女士共同管理该基金。

24. 基金管理人 2018 年 5 月 17 日公告，韩贤旺先生和欧阳沁春先生不再担任汇添富全球移动互联网灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，由杨璿先生单独管理该基金。

25. 《汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》于 2018 年 5 月 23 日正式生效，过蓓蓓女士任该基金的基金经理。

26. 基金管理人 2018 年 5 月 29 日公告，聘任茹奕菡为汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富多元收益债券型证券投资基金、汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金、汇添富双利增强债券型证券投资基金、汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富熙和精选混合型证券投资基金的基金经理助理，协助上述基金的基金经理开展投资管理工作。

27. 《汇添富文体娱乐主题混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 6 月 21 日正式生效，杨璿先生任该基金的基金经理。

28. 本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼事项。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国金证券	2	1,000,332,779.08	100.00%	925,355.90	100.00%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
华泰联合证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-

信达证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
民族证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-

注：此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国金证券	212,234.80	100.00%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

中信建投	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

- (1) 基金交易交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例，并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整，使得总的交易量的分配符合综合排名，同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。
- (4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。
- (5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定，投资总监审批。
- (6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成；更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。
- (7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用，基金会计应负责协助及时催缴。
- (8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定，同一基金管理公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内新增 1 家证券公司的 1 个交易单元：中泰证券（深交所单元），退租 2 家证券公

司的 2 个交易单元：东兴证券（上交所单元）、中投证券（上交所单元）。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金 2017 年资产净值的公告	公司网站	2018 年 1 月 2 日
2	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下证券投资基金执行增值税政策的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 1 月 3 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于增加基金直销账户的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 1 月 17 日
4	汇添富基金管理有限公司旗下公募基金 2017 年第 4 季度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2018 年 1 月 22 日
5	关于汇添富基金管理股份有限公司旗下 93 只基金修订基金合同的公告	中证报, 上交所, 证券时报, 公司网站, 深交所	2018 年 3 月 24 日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下 93 只基金 2017 年年度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2018 年 3 月 28 日
7	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行开展的费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 3 月 30 日
8	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加工商银行开展的费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 3 月 30 日
9	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加途牛金服为代销机构并参与费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 3 月 31 日
10	关于汇添富基金管理股份有限公司办公楼层调整的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 4 月 9 日
11	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加电盈基金为代销机构并参与费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 4 月 9 日
12	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 4 月 19 日
13	汇添富基金管理股份有限公司关	中证报, 上交所, 证	2018 年 4 月 21 日

	于住所变更的公告	券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	
14	汇添富基金旗下 99 只基金 2018 年第 1 季度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所	2018 年 4 月 21 日
15	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加凯石财富开展的费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 4 月 23 日
16	关于汇添富基金管理股份有限公司增加直销传真号码的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 5 月 31 日
17	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 6 月 9 日
18	汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金更新招募说明书摘要 (2018 年第 1 号)	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 6 月 15 日
19	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 6 月 20 日
20	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金 2018 半年资产净值的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2018 年 6 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	154,184,079.99	0.00	853,550.00	153,330,529.99	72.87%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

1、持有人大会投票权集中的风险

当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

2、巨额赎回的风险

持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。

3、基金规模较小导致的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。

4、基金净值大幅波动的风险

持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。

5、提前终止基金合同的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 19-22 楼 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.99fund.com 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2018 年 8 月 25 日